HTF narrative and poi selection is everything!
Perfect LTF entry model in wrong HTF area is worthless

ورود بر اساس نقدینگی و مدل‌های آن

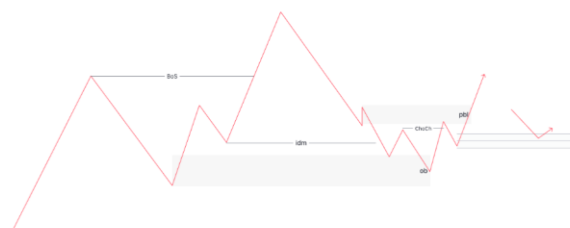
طرح کلی درباره نقدینگی:

۱. آیا در ناحیه فیلیپ سویپ آشکار داریم؟

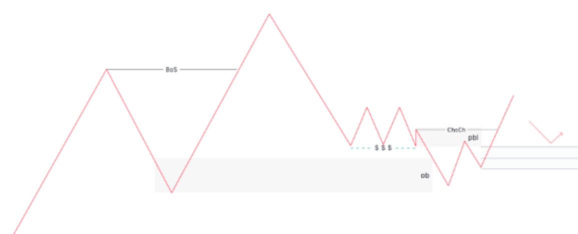
بله: ورود در فلیپ

خیر: آیا نقدینگی چپ در تایم ساختار وجود دارد؟

بله: ورود در فلیپ/اکستریم بعد از سویپ نقدینگی لگ چپ و زدن pbl



خیر: منتظر شکل گیری یک نقدینگی قوی در لگ راست (پولبک هستیم + سویپ نقدینگی و ورود در فلیپ/اکستریم



نشانه موثر بودن نقدینگی (pbl)

هر نقدینگی در صورتی اعتبار دارد که اردربلاک منشا سویپ شدن نقدینگی (pont before liq.=pbl) فیل شود

یعنی اردربلاکی که منشا شکست سطحی است که به عنوان نقدینگی در نظر گرفته‌ایم. به طور اگرسیو می‌توان اولین اردربلاک مخفی رو به عنوان pbl تعیین کرد یا مثل شکل زیر میتونه آخرین حرکت b2s مینور باشه:



این اردربلاک هر وقت بشکند علامت این هست که نقدینگی مورد نظر برای ریورس قیمت مورد استفاده قرار گرفته است. بنابراین تنها در این صورت می‌توان بر اساس اون نقدینگی ترید کرد.

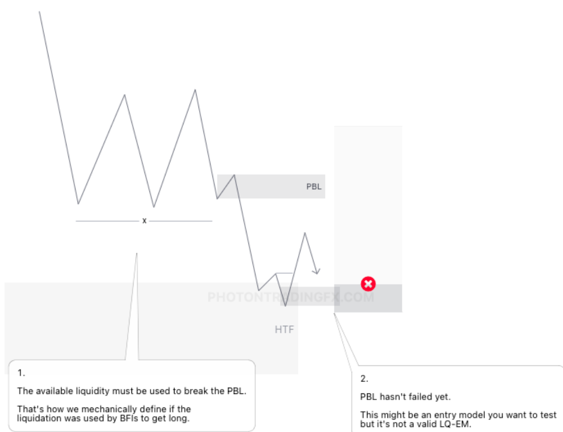
* حتی اگر اون نقدینگی idm لگ چپ باشه

این اردربلاک باید کاملا قبل از سطح نقدینگی باشه اگ سایه ش از سطح عبور کرده منشا شکست نیست چون در واقع آخرین حرکت b2s بعد از شکست رخ داده در این موارد باید بریم یک اردربلاک قبل رو به عنوان pbl بگیریم:

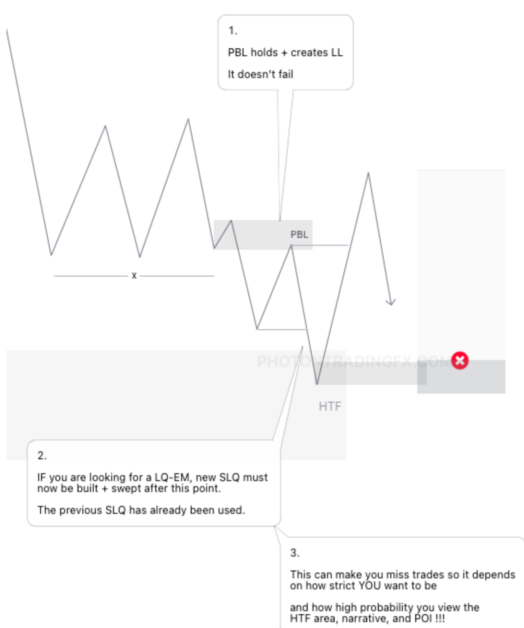


اشتباهات احتمالی درباره pbl:

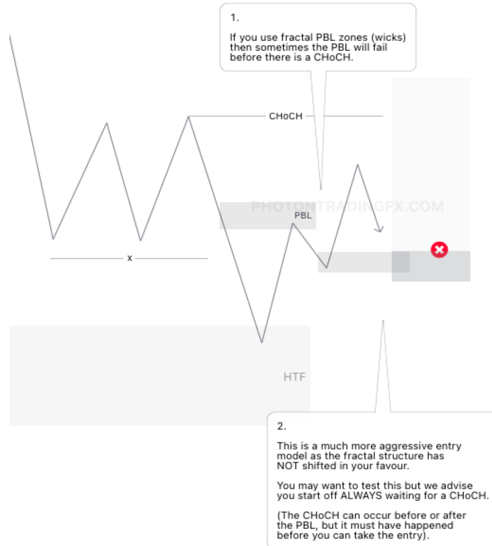
۱. چاک شکل گرفته ولی هنوز pbl فیل نشده



۲. به جای اینکه اردربلاک pbl شکسته شود میتیگیت شده و موجب باس شده باشد:



۳. بعد یا هنگام فیل شدن pbl تایید چاک نداده



مدل‌های پنج‌گانه ورود بر اساس نقدینگی:

در تایید گرفتن از طریق choch در تایم ورود، بهتر است در هنگام شکست سطح choch واکنشی فلیپ سویپ دار را ببینیم زیرا به این معناست که ناحیه شکسته شده از نظر سفارشات مهم بوده و شکست آن اعتبار دارد. در صورتی که فلیپی که داریم فق یک کف دارد یا سویپ معتبری ندارد یکی از مدل های نقدینگی زیر می‌تواند این ضعف را برای ورود در فلیپ جبران کند.

* در تمام موارد اگر فلیپ نداشتیم ورود در اکستریم خواهد بود.

ترتیب این مدل ها در مواردی که نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) نداریم (مدل ۲ به بعد) بر اساس میزان اعتبار: به ترتیب شماره ۲ سپس ۳و۴ و سپس ۵ است.

مدل 1

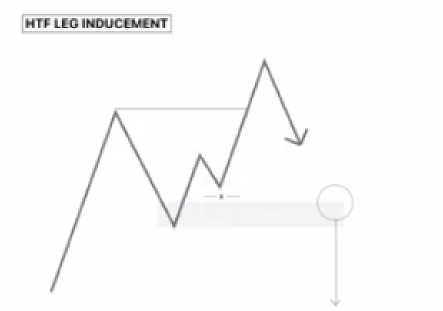
۱ـ نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) داریم

۲ـ نقدینگی راست (نقدینگی پولبک یا pbid) نداریم

۳ـ قیمت در تایم بالا یک نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) را "که به اردربلاک نزدیک بوده" زده (اگر دور بود هم میشه ولی باید pbl مربوط به همان نقدینگی زده بشه تا بشه گفت نقدینگی عمل کرده)

۴- زدن pbl و چاک

= امکان ورود در فلیپ ساده (بدون سویپ)





مدل 2A:

۱ـ نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) نداریم

۲ـ نقدینگی آخرین سقف ساختار داخلی زده شده

۳ـ شکست یا زدن نقدینگی کف قوی ای که در اثر حرکت فوق ایجاد شده (به عنوان pbid)

۴- زدن pbl و چاک

= امکان ورود در فلیپ ساده (بدون سویپ)



مدل 2B:

۱ـ نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) نداریم

۲ـ نقدینگی دو کف (به عنوان pbid) در محل آخرین کف

۳ـ زدن pbl و چاک

۳ـ ورود در فلیپ ساده (بدون سویپ)



مدل 3A:

۱ـ نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) نداریم

۲ـ نقدینگی راست (نقدینگی پولبک یا pbid) نداریم

۳ـ فلیپ بدون سویپ داریم که ممکن است تبدیل به idm برای اکستریم شود (بنابراین چون نقدینگی چپ و راست نداریم فیل شدن فلیپ را در صورت وقوع به عنوان نقدینگی تلقی می‌کنیم)

۴ـ قیمت قبل شکست فلیپ واکنش جزیی می‌دهد (pbl) و بعد از شکست فلیپ به اکستریم واکنش می دهد

۵ـ بعد از واکنش بر می‌گردد و اردربلاک pbl (منشا شکست فلیپ) را با واکنش جزیی چاک میکند. بنابراین یک ناحیه فلیپ جدید شکل گرفته که اردربلاک مناسبی برای ورود است

۶ـ در صورتی که شرط سوم وجود نداشت صبر میکنیم تا اگر اکستریم را سویپ کرد آن را به عنوان نقدینگی تلقی می کنیم و در این صورت طبق مدل 2A ورود می‌کنیم

این مدل ورود با تایید اضافه (ce) است ولی امکان ورود مستقیم در اکستریم با پذیرش ریسک بالاتر وجود دارد مخصوصا وقتی چاک مورد نظر در داخل یک اردربلاک قوی شکل گرفته که فکر می‌کنید ارزش ریسک کردن را دارد. مثلا اردربلاک اکستریم تایم ساختار از اردربلاک ابتدای ناحیه ی دیسکانت قدرت بیشتری دارد [یا در مواقعی که مومنتوم بالایی بعد از اردربلاک تایم ساختار شکل گرفته]



مدل 3B:

۱ـ نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) نداریم

۲ـ نقدینگی راست (نقدینگی پولبک یا pbid) نداریم

۳ـ فلیپ اولیه سویپ ندارد پس شکست آن را نقدینگی تلقی می‌کنیم برای منطقه اکستریم

۴ـ قیمت در برگشت از اکستریم به ناحیه pbl فلیپ واکنش جزیی می‌دهد و فلیپ جدیدی می‌سازد

۵ـ ورود (ce) در ناحیه فلیپ



مدل 4:

۱ـ نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) نداریم

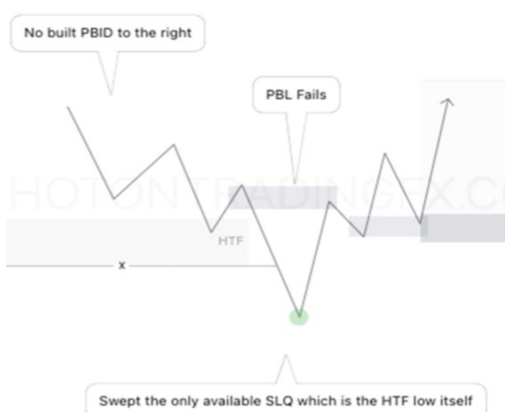
۲ـ نقدینگی راست (نقدینگی پولبک یا pbid) نداریم

۳ـ کف اردربلاک اصلی (تایم بالا) سویپ شده یعنی قیمت با سرعت از آن گذشته و برگشته

۴ـ موقع چاک، ناحیه فلیپ تشکیل شده

۵ـ ورود (ce) در ناحیه فلیپ

(این مدل به دلیل ابهام در سویپ / شکست اردربلاک تایم بالا کمی ریسکی تر است)



مدل 5:

۱ـ فلیپ دارای دو کف است که کف دوم کف اول را سویپ کرده

۲ـ ورود در فلیپ



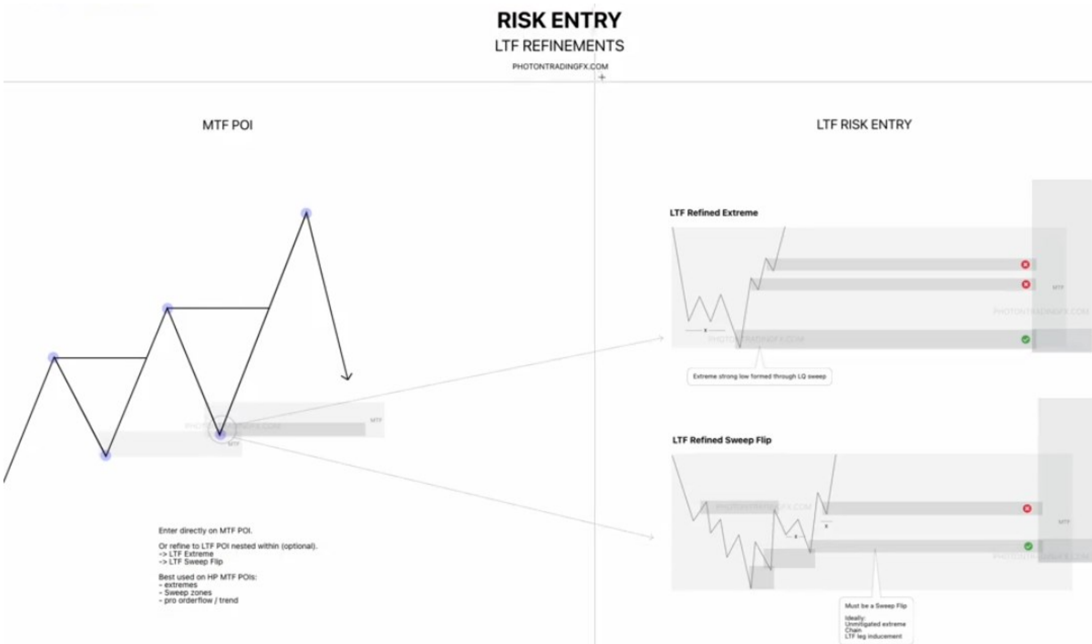
انواع ورود بر اساس تایید

۱. ورود re یا ریسکی (بدون تایید اضافه):

ـ ورود در ob ساختار میانی مشروط بر اینکه در جهت روند اردرفلو باشد.

ـ بهتر است در منطقه اکستریم باشد یا در مورد چاک در ناحیه فلیپ+سویپ باشد.

ـ می توان آن را به اردربلاک های مصرف نشده و قوی تایم پایین تر ریفاین کرد:



۲. ورود با تایید (ce) یا تایید دوبل (dce):

ـ ورود با تایید چاک تایم مینور

ـ در صورت وجود معیارهای اعتبار چاک

ـ به همراه یکی از نقدینگی های هفت گانه

ـ برای تایید دوبل باید بعد از چاک یک باس هم شکل گرفته باشد و ورود در منشا باس است

مدلهای ورود بر اساس گام های حرکتی

فاز ۱ (در جهت اردرفلوی ۱۵)

ورود در منطقه دیسکانت و یا اکستریم سوینگهای تایم فریم میانی در جهت روند تایم ساختار

چاک تایم میانی نیاز نیست و فقط تایید تایم مینور کافی است

تارگت: سوینگ لو/های ضعیف تایم میانی و بعد تایم ساختار

فاز ۲ (پایان پولبک ٤اچ)

ورود در منطقه دیسکانت/اکستریم تایم ساختار بعد از شکل گیری چاک در تایم فریم میانی (۱۵ مین)

در صورتی که قیمت به منطقه اکستریم رسیده می‌توان ورودهای اگرسیو تر داشت (بدون چاک تایم میانی)

بهتر است چاک تایم میانی + چاک تایم پایین هر دو شکل در نظر گرفته شود

تی پی اول اولین سقف/کف تایم میانی (۱۵ مین) است

بنابراین ورود در صورتی منطقی است که ریوارد تا اولین سقف/کف تایم میانی بصرفه باشد

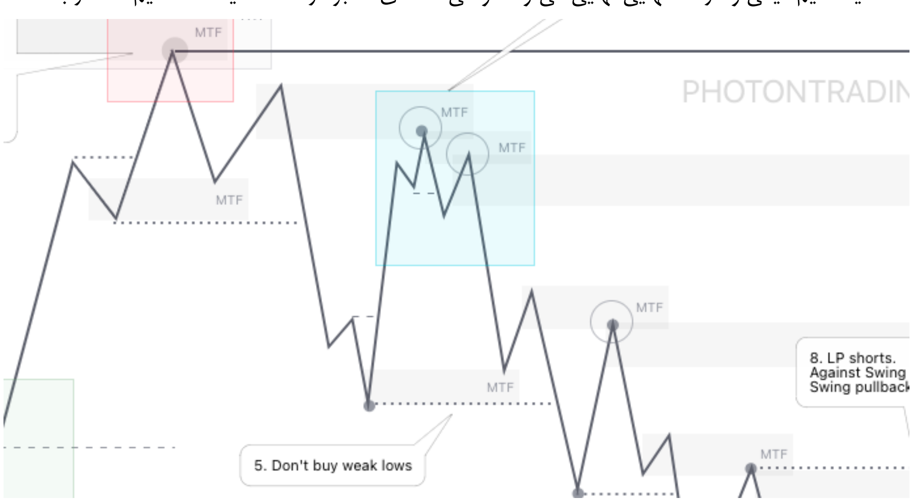
وقتی فاصله قیمت از شکست باس زیاد است:

- در مواردی که قیمت بعد شکست از خط باس (۱۵م) فاصله زیاد گرفته است
- ورود در اولین اردربلاکی که تایید بدهد
- تارگت های کوچک (سقف/کف ضعیف ۱۵م)
- شکل گیری مومنتوم در شروع روند باشد بهتر است
- مشروط بر اینکه ناحیه ساختاری/عرضه و تقاضا مهم مخالف نزدیک نیست
- مومنتوم قوی در باس نشان دهنده قوت زیاد کل اردرفو و به خصوص منطقه اکستریم است

فاز ۳ (در جهت اردرفلوی ۱۵ و خلاف روند ٤ اچ)

ورود در جهت اردرفلوی تایم میانی (۱۵ مین) تا وقتی قیمت به منطقه دیسکانت یا اکستریم تایم ساختار نرسیده

تارگت اصلی کف/سقف ضعیف تایم میانی و تارگت نهایی نهایی می‌تواند نواحی تقاضای معتبر در منطقه دیسکانت تایم ساختار باشد



فاز ٤ (شروع پولبک ٤ اچ)

قیمت در جایی که شروع پولبک ۴اچ انتظار می رود یک اردربلاک ۱۵ مین را میتیگیت کرده (اگر اردربلاک اصلی متعلق به ۴ اچ بود باید ریفاین شـده آن از ۱۵ مین میتیگیت شود)

اگر یک ناحیه تایم میانی را میتیگیت کرده بود (ترجیحا در صورت ct/cof) با انواع ورود تایم پایین وارد میشویم و اگر هیچ ناحیه تایم میـانی را متیتیگیـت نکرده باید یا چاک ۱۵م زده باشد

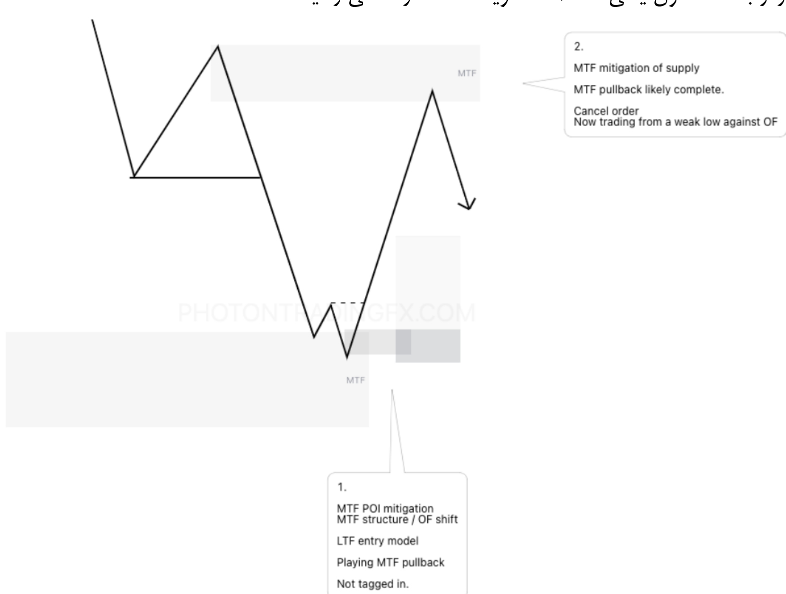
تارگت روی یک اردربلاک در منطقه دیسکانت سوینگ ۱۵م

کنسل کردن اردر

١. بعد از چاک، ساختار صعودی شکل گرفته و قیمت برای برگشت به منشا چاک باید سقف/کف های متعدد را رد کند



٢. قیمت قبل از تگ شدن اردر به هدف اول یعنی سف/کف سوینگ ساختار داخلی رسیده



چک لیست

تایم هفتگی و روزانه از نظر ساختار، نقدینگی های/لو و خط روندها بررسی شد

سناریوی جایگزین در تمام سه تایم بررسی شد

تایم ساختار

- قیمت در فاز آ / ب است
- سوینگ های و لو / باس ترسیم شد
- عمق باس مناسب است
- اردربلاک‌های مصرف شده و نشده ی منشا باس در منطقه دیسکانت ترسیم شد
- اردربلاک imb /سویپ دارد
- نقدینگی ها مشخص شد
- قیمت با فشردگی / تهاجمی به اردربلاک نزدیک شده
- مصرف ۳۰-۵۰ درصد اردربلاک

تایم میانی

- باس (فاز آ) یا چاک (فاز ب) ترسیم شد
- ناحیه فلیپ (در صورت وجود) ناشی از واکنش به یک اردربلاک مصرف نشده بوده (اولویت)
- عمق باس مناسب است (فاز آ)
- قیمت با فشردگی / تهاجی به اردربلاک نزدیک شده
- نقدینگی‌ها ترسیم شد
- تایم خبر چک شد

تایم ورود

- تایم ۳ـ۵ مین
- اردربلاک منشا چاک ترسیم شد
- قیمت با فشردگی / تهاجی به اردربلاک نزدیک شده
- نقدینگی‌ها ترسیم شد
- (اگر دو اردربلاک داشتیم: دو ورود با ریوارد بالا بهتر از یک ورود (به اندازه هر دو ناحیه) با ریوارد کم است)

مدیریت ریسک و پوزیشن

ریسک: ۰.۲ تا ۰.۵

تعداد تی پی: ۲

دوسوم تی پی اول/ یک سوم تی پی دوم

حداقل ریوارد:

تی‌پی اول=۵ مگر اینکه اولین مقاومت بالاتر باشه

تی‌پی دوم= سقف/کف نهایی یا یک سقف/کف مهم تایم میانی

تریل و بریک ایون:

فقط بعد از تثبیت بالای سقف/کف ضعیف ساختار داخلی مجاز است (مثلا بعد از زدن دو باس بعد ورود)

برایند ۱۰ پوزیشن ریوارد ۴-۱۰ با وین ریت ۳۰ اگر دو مورد فق تی پی یک بخورد یک مورد تی پی دو (ریسک ۰.۲) :

۷۰ دلار+۷دلار ضرر

یک سود ریوارد ۸ (۱۰۰ دلار) + دو سود ریوارد ۴ (۴۶ دلار)

۲۰ دلار کمیسیون/اسپرد

= ۴۹ دلار سود

براینده ۱۰ پوزیشن ریوارد چهاری با وین ۳۰ اگر کل حجم روی تی پی ۱ خارج شویم (ریسک ۰.۲) میشه:

۷۰ دلار ضرر

۱۲۰ دلار سود

۲۰ دلار کمیسیون/اسپرد

= ۳۰ دلار سود

اگر حجم به ۰.۴ افزایش یابد:

براینده ۱۰ پوزیشن ریوارد ۴-۱۰ با وین ۳۰ اگر دو مورد فق تی پی یک (4r) بخورد یک مورد تی پی دو(10r) با ریسک ۰.۴ میشه:

۷ پوزیشن ۲۰ دلاری ضرر=۱۴۰ دلار

یک پوزیشن ریوارد ۱۰=۲۰۰ دلار

دو پوزیشن تی پی یک (ریوارد ۴)=۸۰-۱۳=۷۷دلار

مجموعا ۱۳۷ دلار سود – ۳۵$ کمیسیون/اسپرد = ۱۰۲ دلار

اگر وین به ۵۰ افزایش یابد:

براینده ۱۰ پوزیشن ریوارد ۴-۱۰ با وین ۵۰ اگر سه مورد فق تی پی یک بخورد دو مورد تی پی دو (ریسک ۰.۲) میشه:

۵۰ دلار ضرر

دو سود ریوراد ۱۰ (۲۰۰ دلار) + سه سود ریوارد ۴ (۷۰ دلار)

۲۰ دلار کمیسیون/اسپرد

= ۲۰۰ دلار